

Fecha de Publicación: 13 de Abril de 2007
 Fecha de Información: 11 de Abril de 2007 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$228,4 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 1,1%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

Rango	Sector Financiero		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3-14	10,8	23,9	20,9	7,8	31,7
15-35	63,8	50,6	32,6	45,8	96,3
36-60	28,0	24,0	11,0	15,0	39,0
61-90	0,0	0,8	0,8	0,0	0,8
91-180	8,8	5,7	5,2	8,3	14,0
>180	39,4	7,2	7,2	39,4	46,6
Total	150,7	112,2	77,7	116,2	228,4

* Cifras en millones de dólares

Cuadro No. 2
Devaluación Implícita Anualizada

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3-14	-0,7 %	2,2 %
15-35	0,4 %	0,0 %
36-60	1,3 %	1,0 %
61-90	3,8 %	2,9 %
91-180	2,8 %	2,2 %
>180	2,7 %	2,2 %
Total	1,3 %	1,1 %

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.³

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

Sectores	9 al 13 de Abril				16 al 20 de Abril				23 al 27 de Abril			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
Financiero	52	41	979	746	6	28	583	552	3	48	905	638
Real	41	52	567	799	28	6	452	483	48	3	405	673
Total	93	93	1546	1546	35	35	1035	1035	51	51	1311	1311

* Cifras en millones de dólares

¹ Datos provisionales.

² La fórmula para la devaluación implícita es: ((Tasa Pactada/Promedio SET FX) ^ (365/Plazo)) - 1

³ A partir del 12 de abril se presenta la proyección de vencimientos.